

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

스마트인덱스모

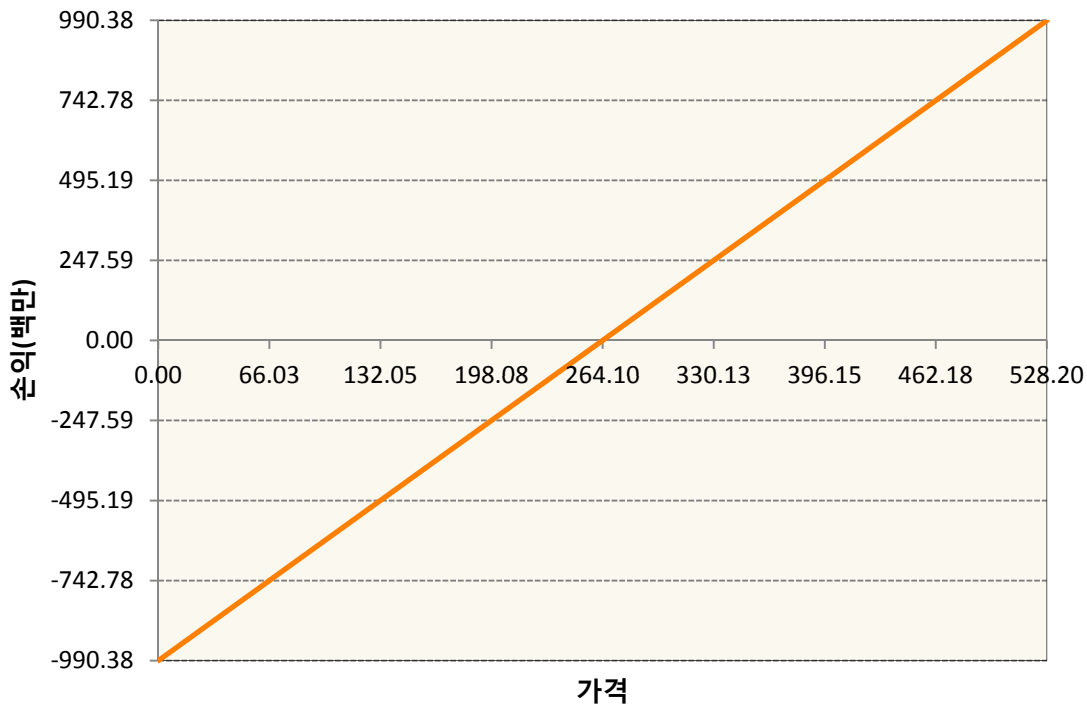
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	990	0	990	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

79

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

65

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,259	0	14,259	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180822

1,061

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

498

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

257

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

유로인덱스모(주식-파생형)

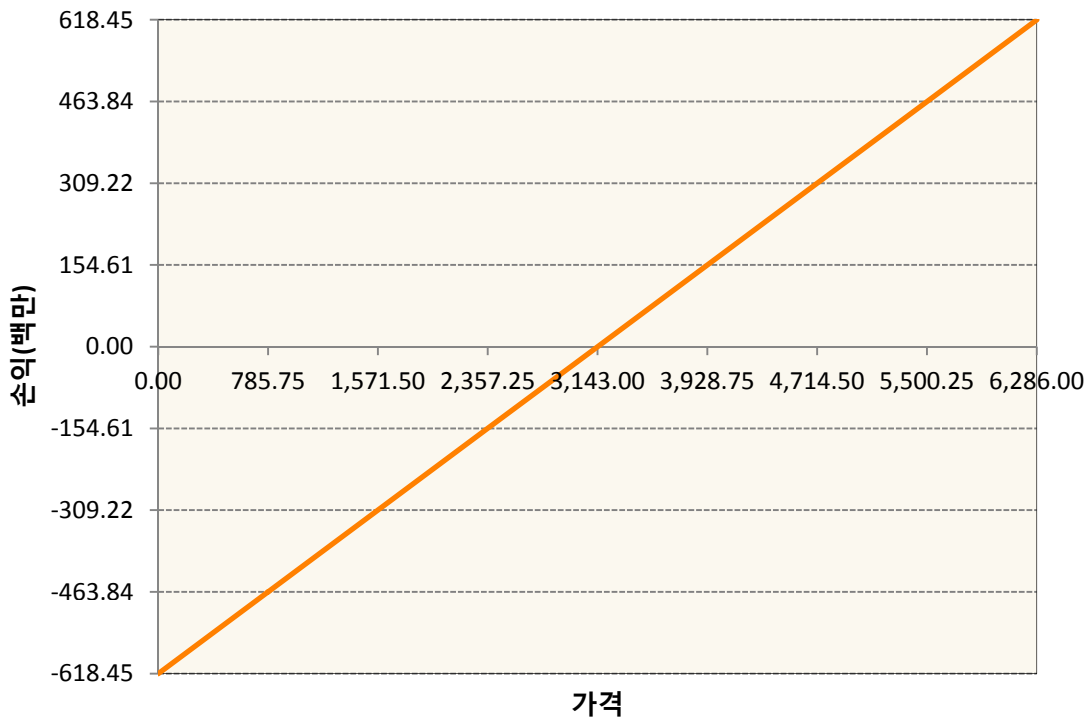
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	618	0	618	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	49
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

31

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

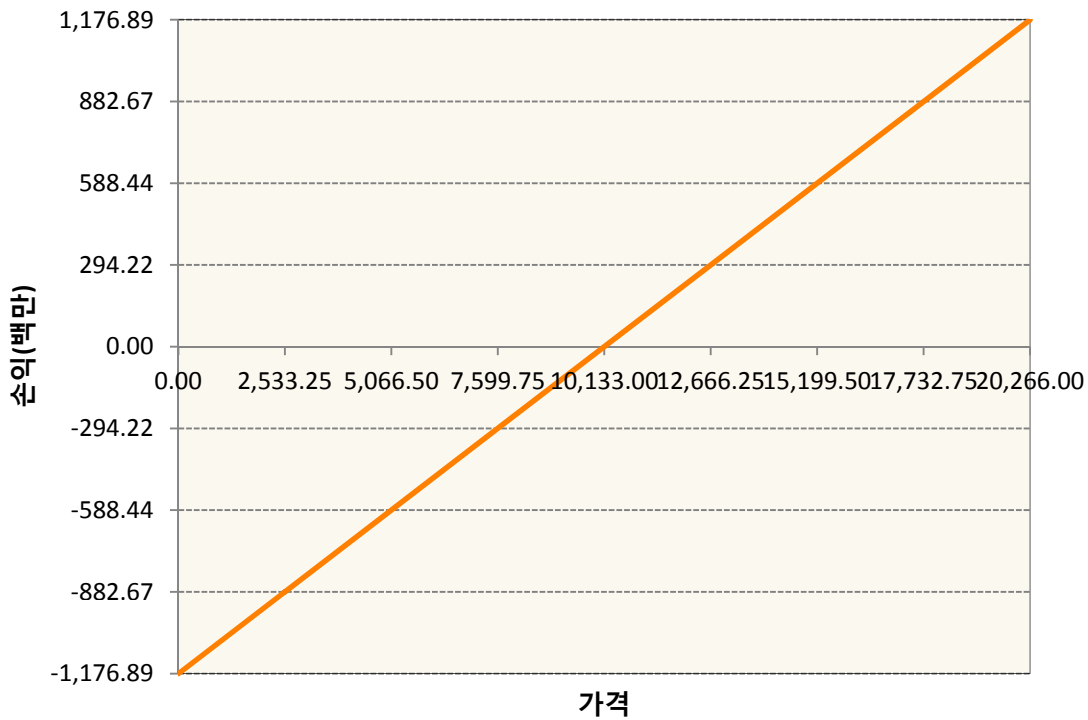
1. 계약금액

(단위:백만원)

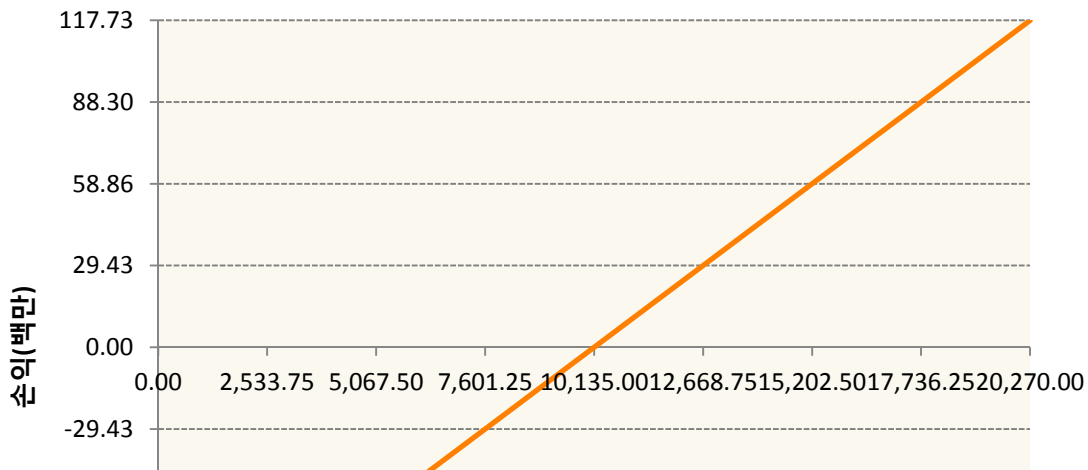
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,295	0	1,295	장내

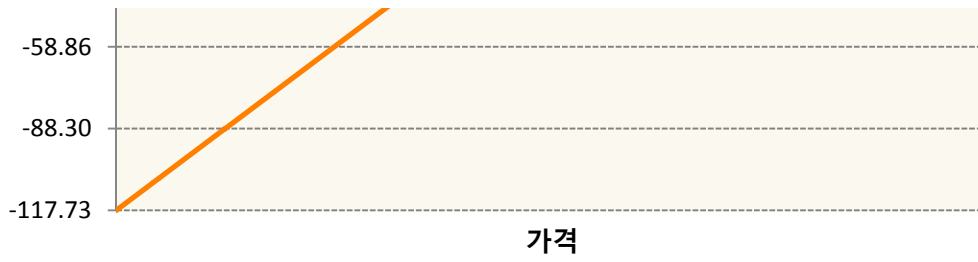
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	94
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

100

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

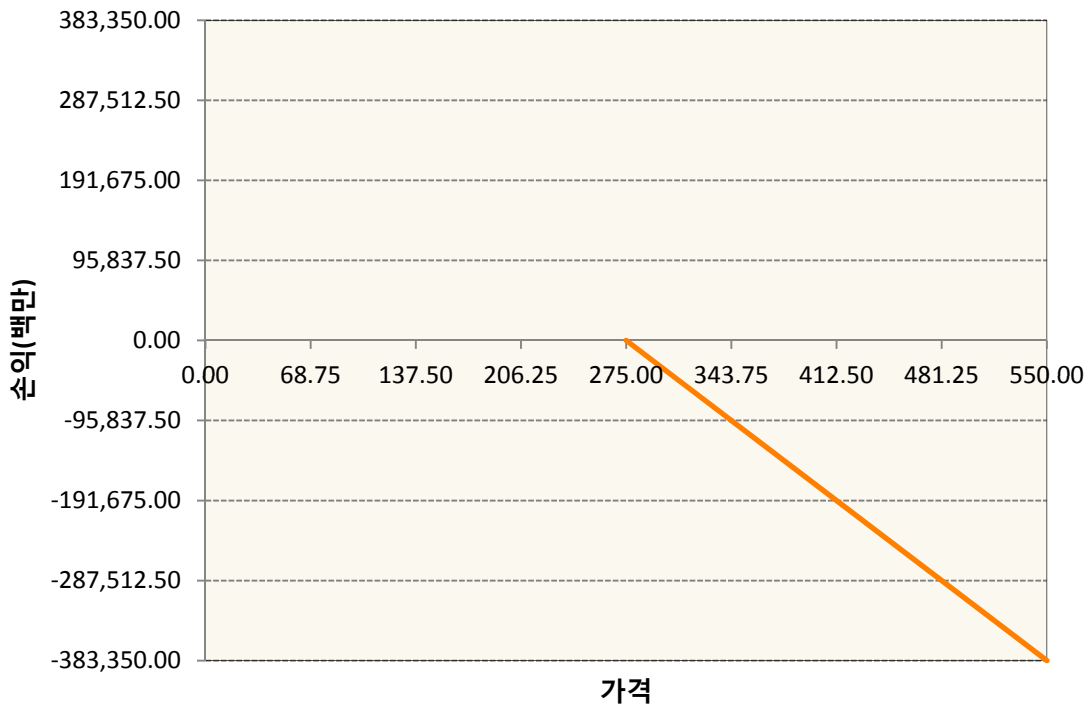
1. 계약금액

(단위:백만원)

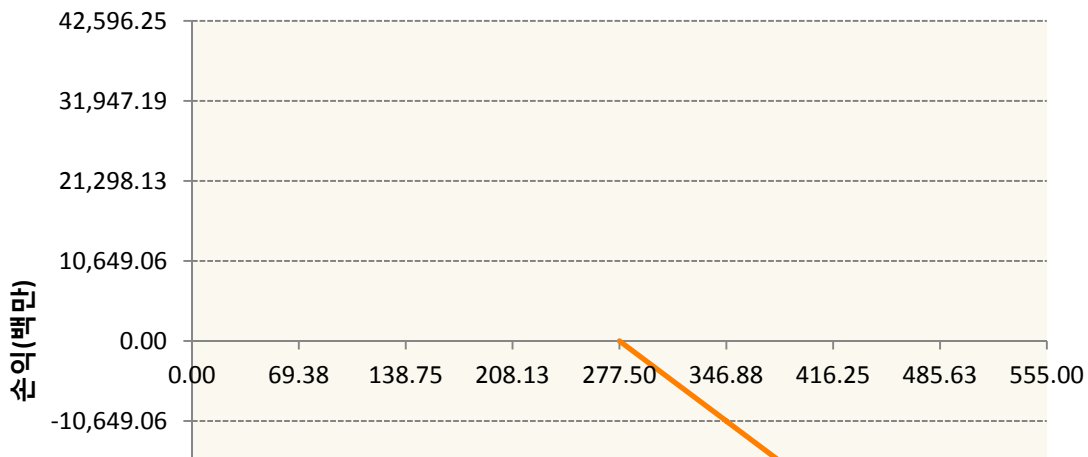
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

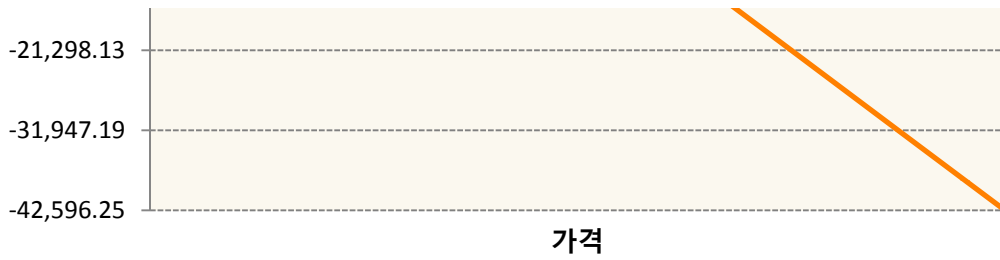
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

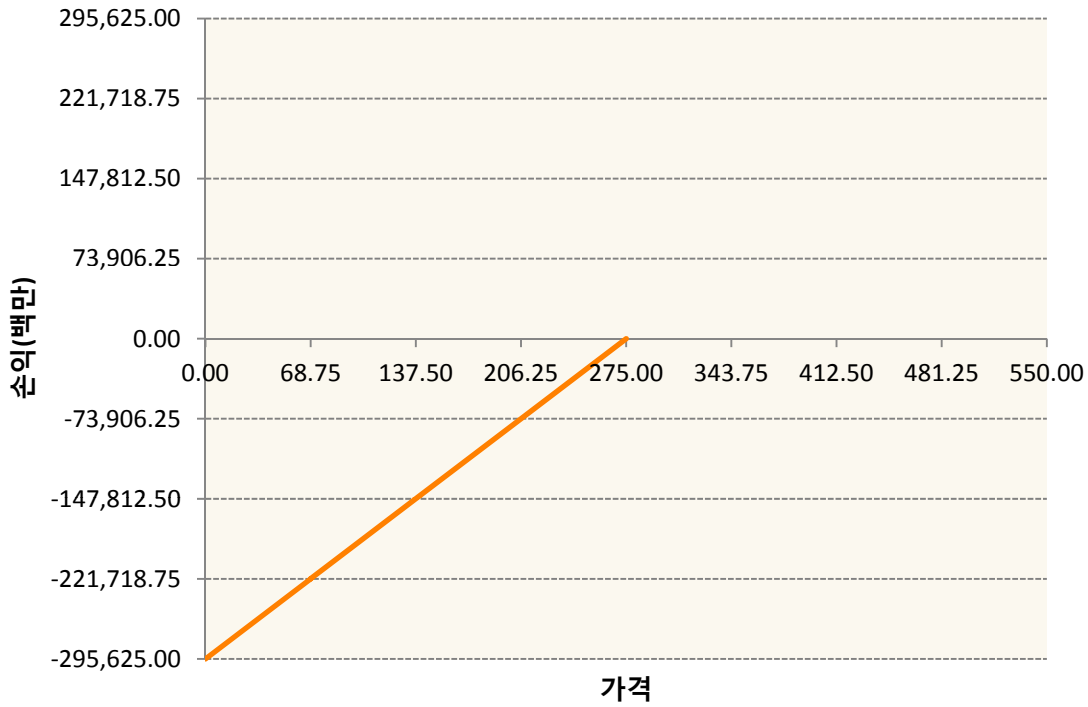


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

15,650

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,325	1,324	1,323	1,319	1,311	1,297	1,275
-5.33%	1,322	1,314	1,299	1,272	1,229	1,168	1,087
-2.67%	1,267	1,207	1,119	1,002	854	678	476
0%	813	576	303	0	-329	-680	-1,050
2.67%	-1,125	-1,599	-2,082	-2,571	-3,065	-3,563	-4,065
5.33%	-5,882	-6,383	-6,889	-7,398	-7,911	-8,426	-8,944
8.00%	-13,488	-13,780	-14,107	-14,461	-14,839	-15,237	-15,650

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,498

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	94	93	92

-5.33%	95	95	94	92	89	85	79
-2.67%	92	89	83	74	63	49	31
0%	66	48	26	0	-29	-61	-96
2.67%	-73	-118	-164	-213	-263	-314	-365
5.33%	-477	-536	-594	-653	-711	-770	-828
8.00%	-1,213	-1,256	-1,301	-1,348	-1,396	-1,447	-1,498

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,299

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,297	-22,297	-22,297	-22,297	-22,298	-22,298	-22,299
-5.33%	-14,733	-14,733	-14,734	-14,735	-14,739	-14,746	-14,757
-2.67%	-7,172	-7,178	-7,191	-7,213	-7,246	-7,291	-7,348
0%	288	213	117	0	-135	-286	-451
2.67%	6,853	6,599	6,337	6,068	5,794	5,516	5,235
5.33%	10,810	10,532	10,250	9,963	9,674	9,382	9,088
8.00%	12,049	11,943	11,814	11,665	11,498	11,315	11,120

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

38,569

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

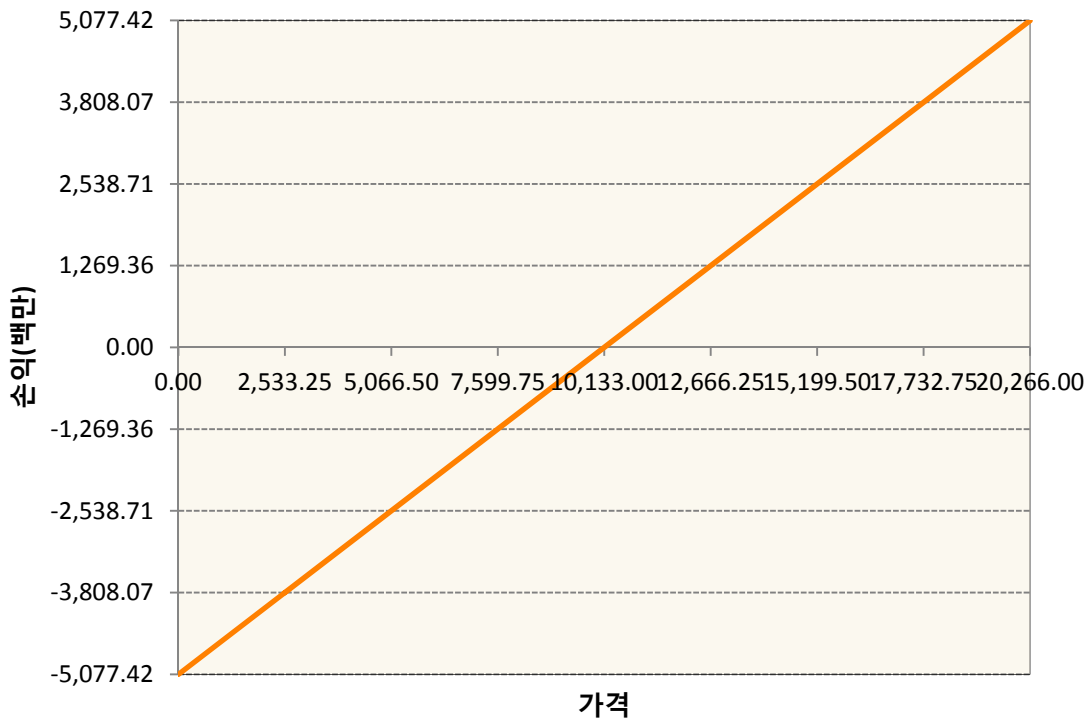
1. 계약금액

(단위:백만원)

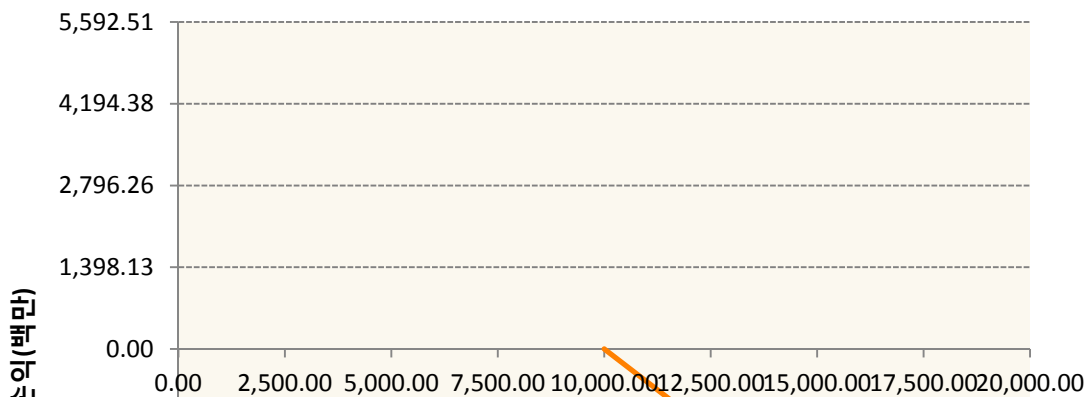
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,077	0	5,077	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,185	-11,185	장내

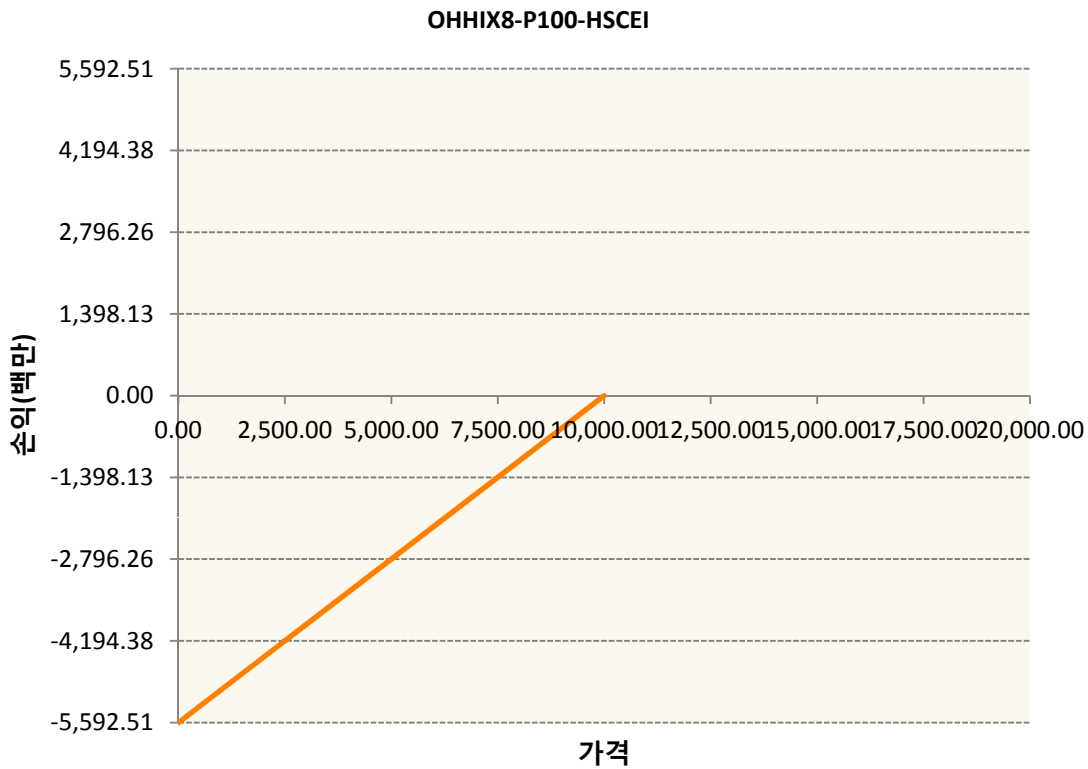
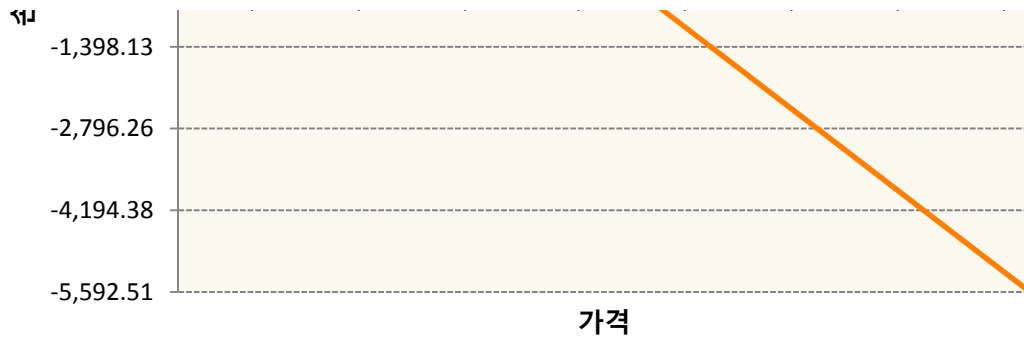
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	406
	OHHIX8-C1C HSCEI	447
	OHHIX8-P10 HSCEI	447

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,259

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

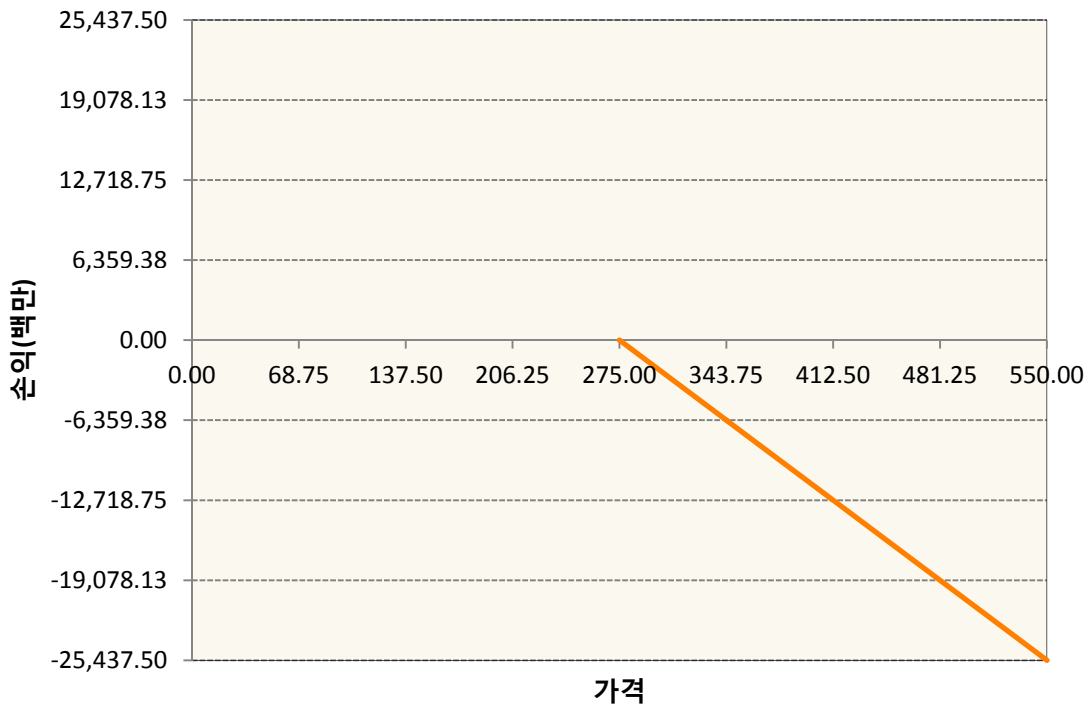
1. 계약금액

(단위:백만원)

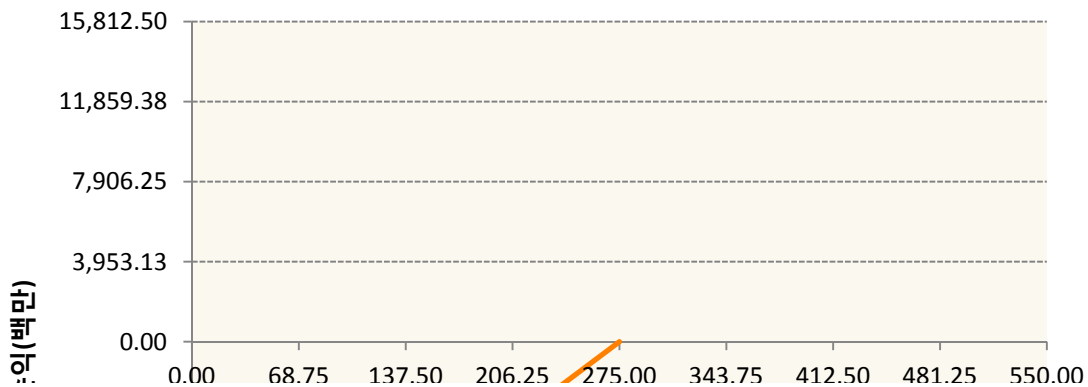
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	5,000	-5,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

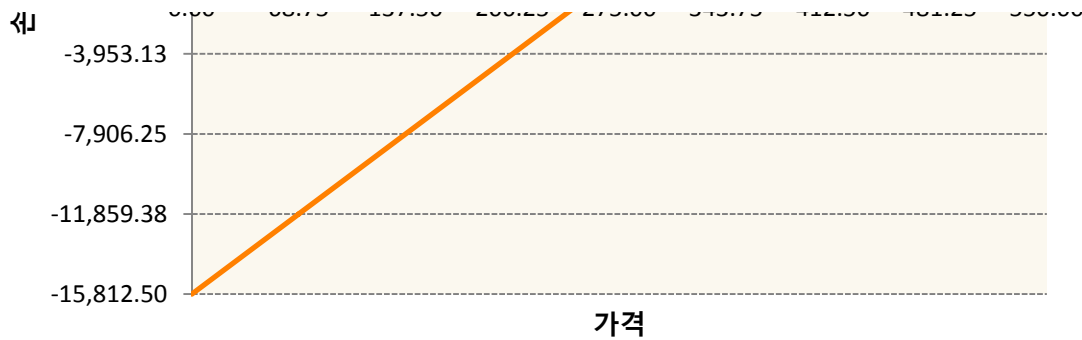
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

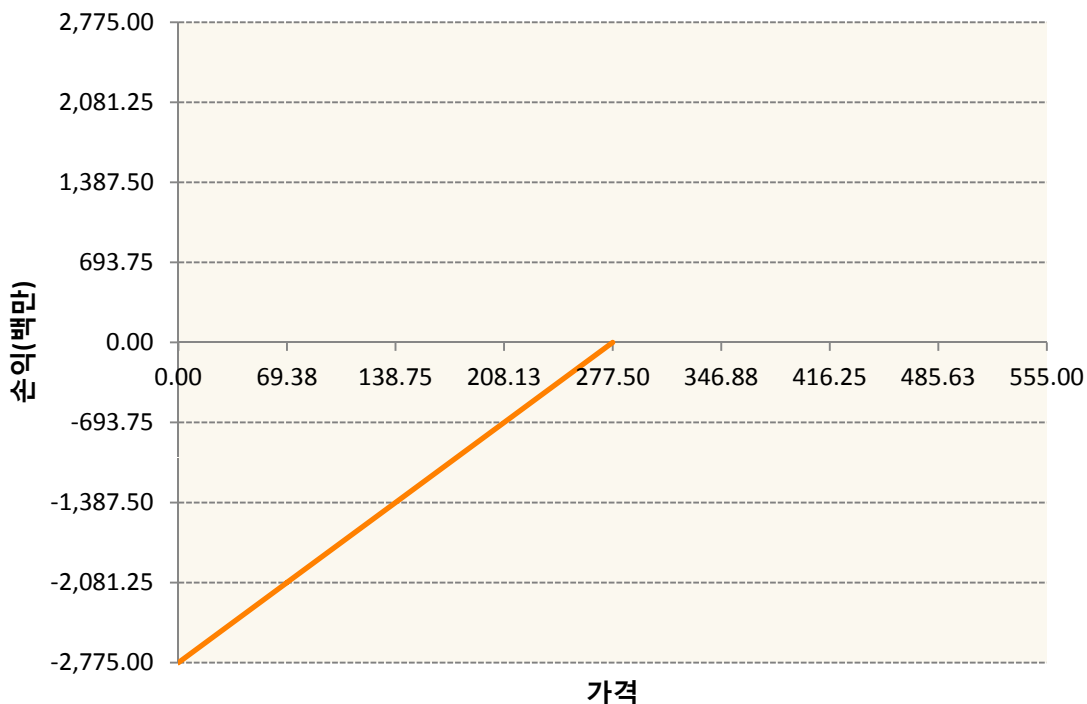


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14							3,618
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,618	-3,618	-3,618	-3,618	-3,618	-3,618	-3,618
-5.33%	-2,412	-2,412	-2,412	-2,412	-2,412	-2,412	-2,412
-2.67%	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206
5.33%	2,412	2,412	2,412	2,412	2,412	2,412	2,412
8.00%	3,618	3,618	3,618	3,618	3,618	3,618	3,618
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,038
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	87	86	85
-5.33%	88	87	86	84	82	77	72
-2.67%	84	80	74	66	57	45	32
0%	54	38	20	0	-22	-45	-70
2.67%	-75	-106	-138	-171	-203	-236	-270
5.33%	-390	-424	-457	-491	-525	-559	-593
8.00%	-895	-914	-936	-960	-985	-1,011	-1,038

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,193

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
-5.33%	-788	-788	-788	-788	-788	-789	-789
-2.67%	-384	-384	-385	-386	-388	-390	-393
0%	15	11	6	0	-7	-15	-24
2.67%	367	353	339	325	310	295	280
5.33%	578	563	548	533	517	502	486
8.00%	644	639	632	624	615	605	595

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

209

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-68	-68	-69	-69	-69	-69	-69
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	67	65	63	61	59	57	55
5.33%	114	111	108	105	102	100	97
8.00%	133	131	130	128	126	124	121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

6,014

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

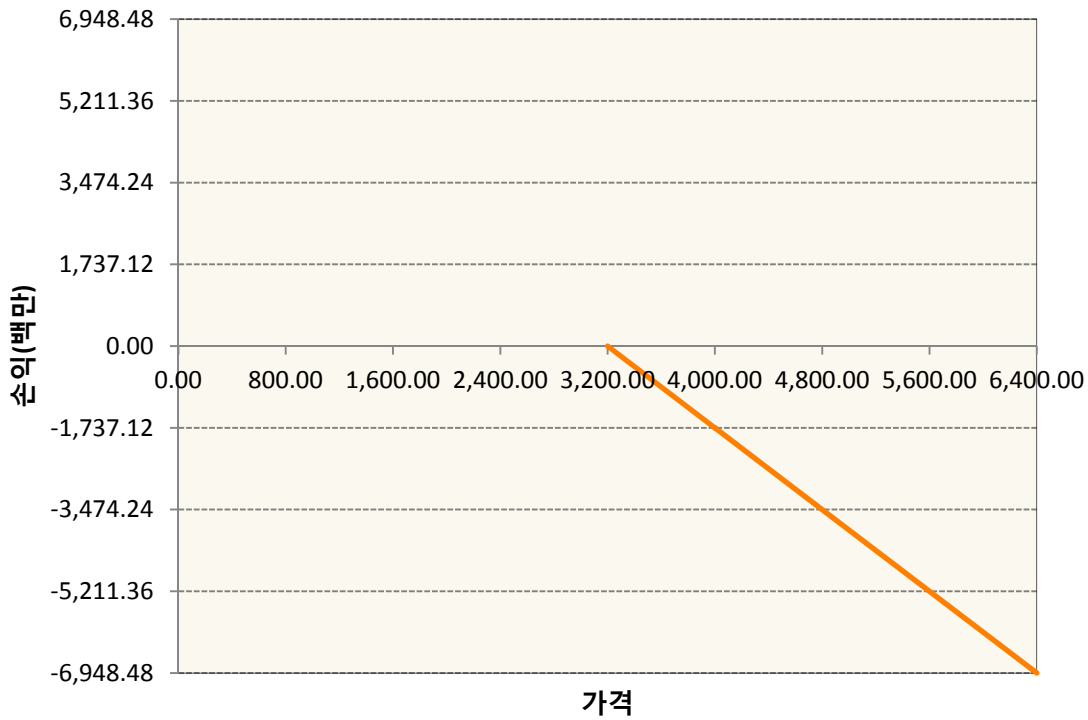
1. 계약금액

(단위:백만원)

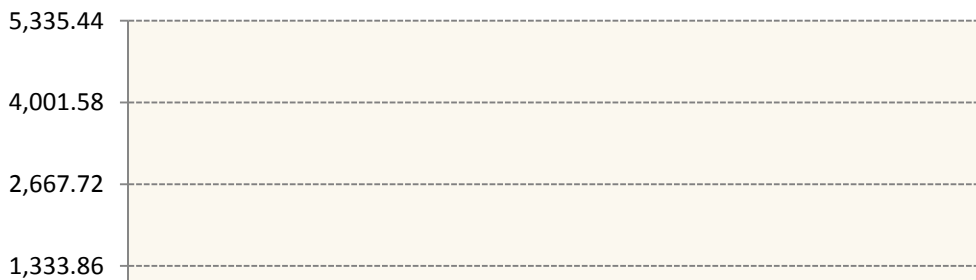
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,775	0	5,775	
누계	유가증권	스왑	72,189	0	72,189	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,568	-24,568	장내

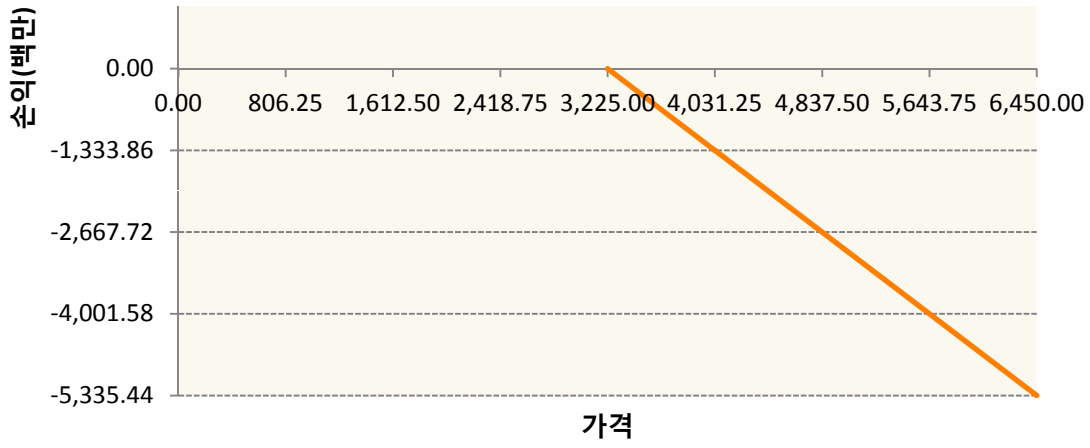
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

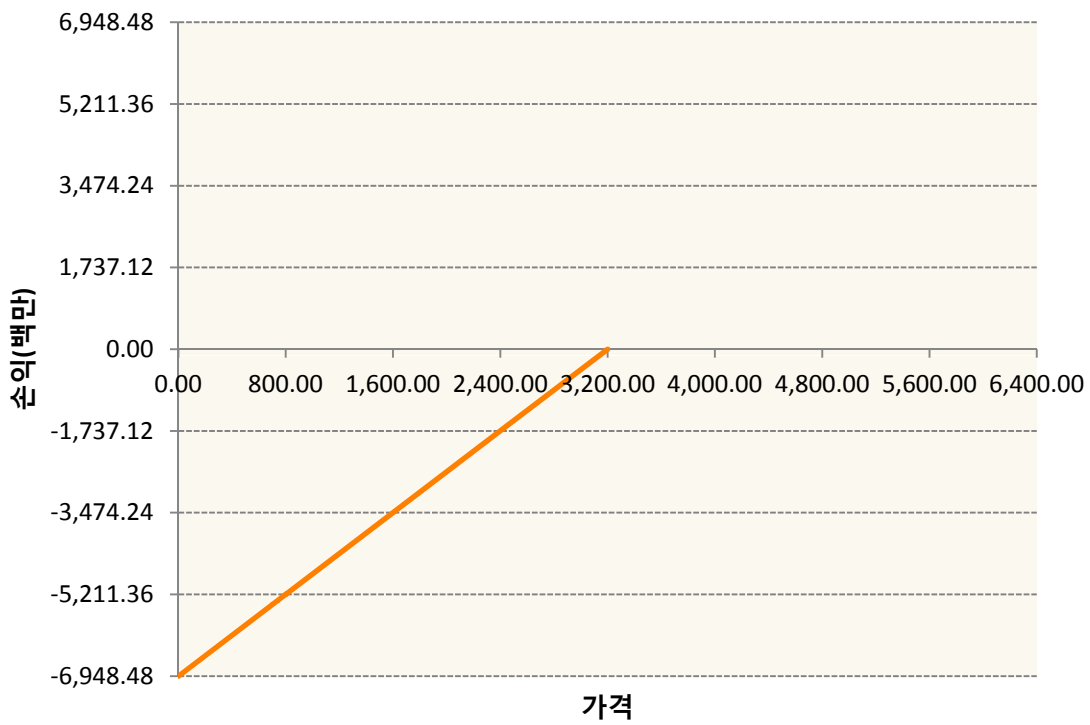


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

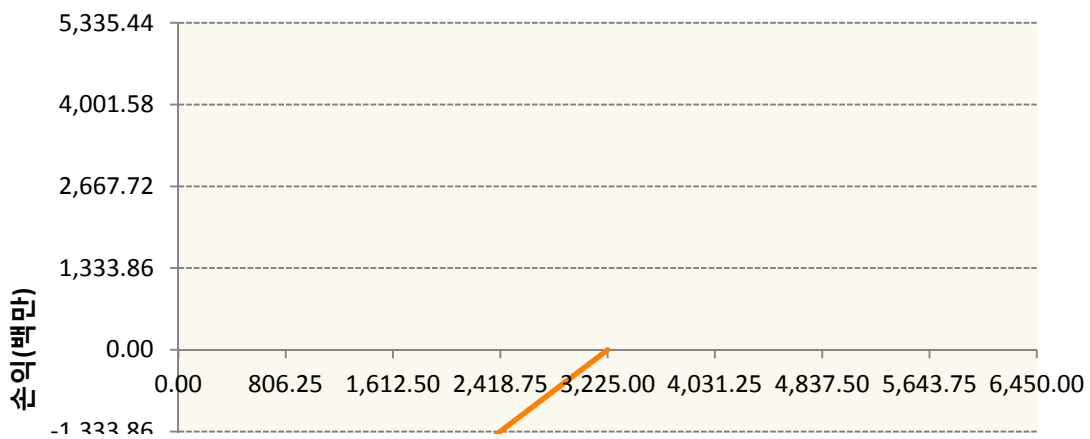


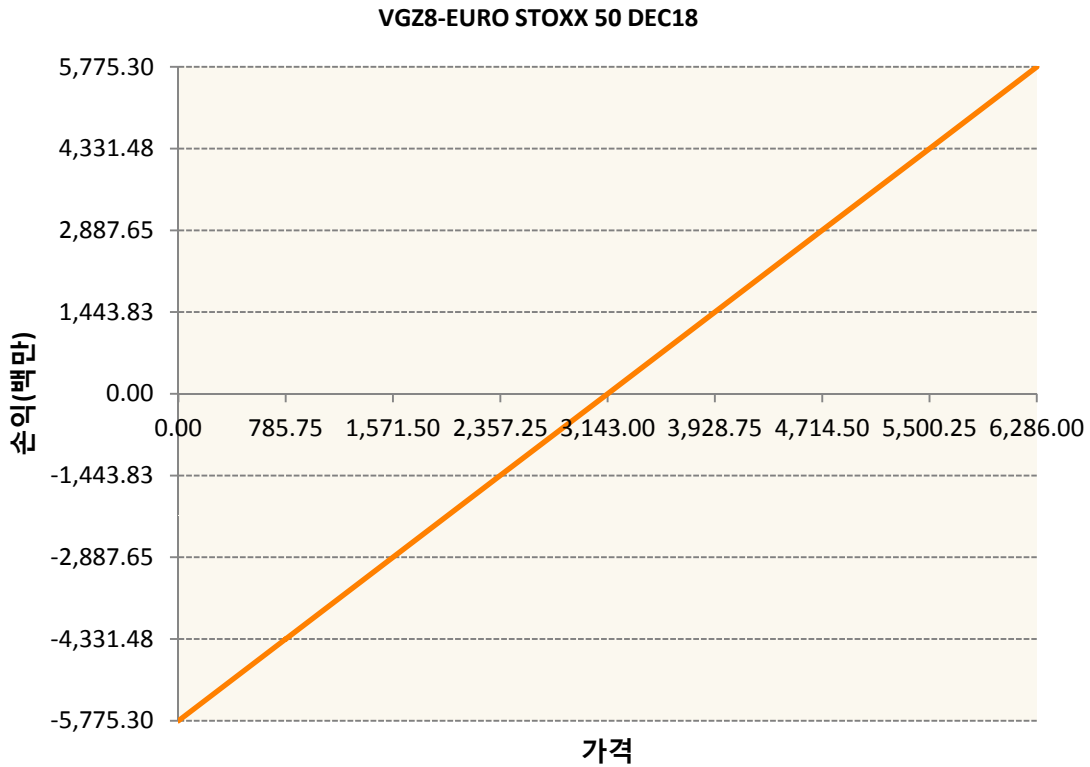
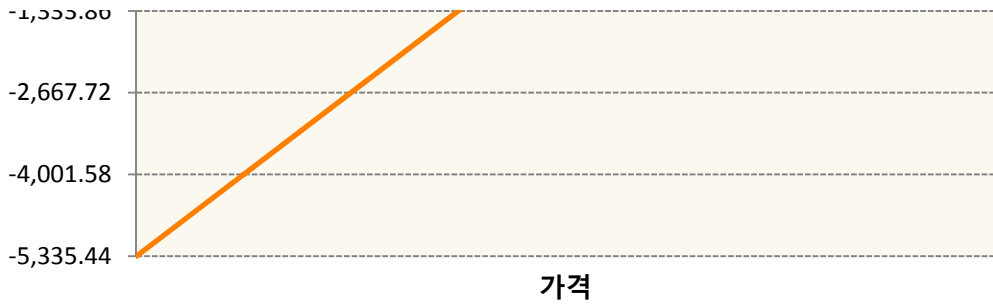


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	66
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	556
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	427
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	556
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	427
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	462

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

1,606

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,094

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

87

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

131

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

148

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

스마트KRX300인덱스목표전환형1

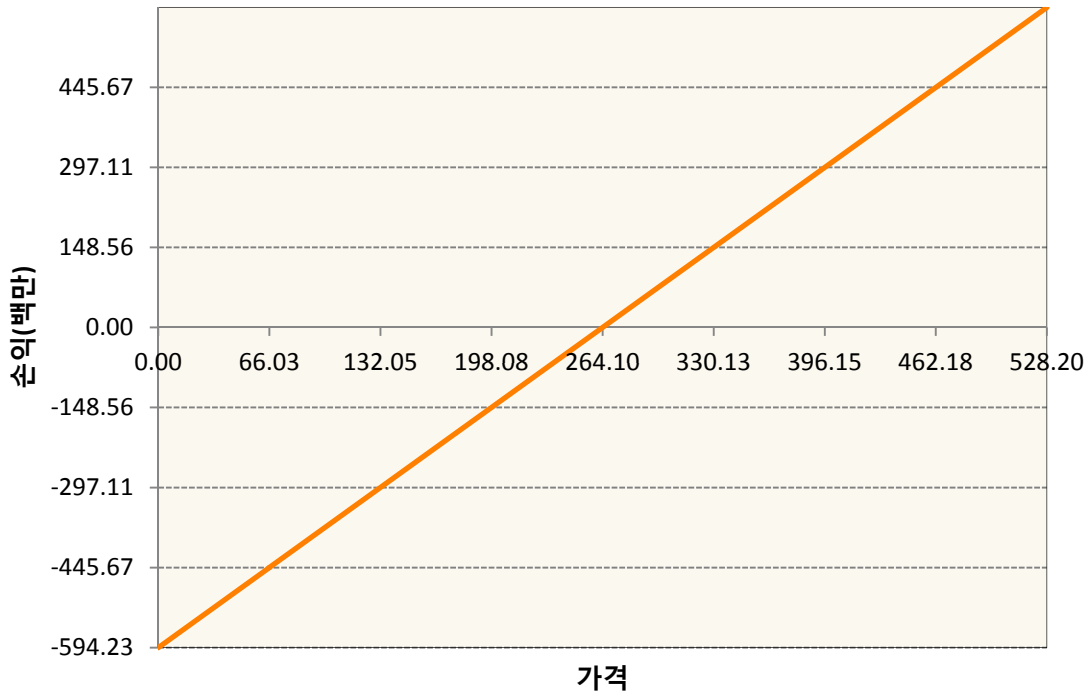
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	594	0	594	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

48

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

39

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간

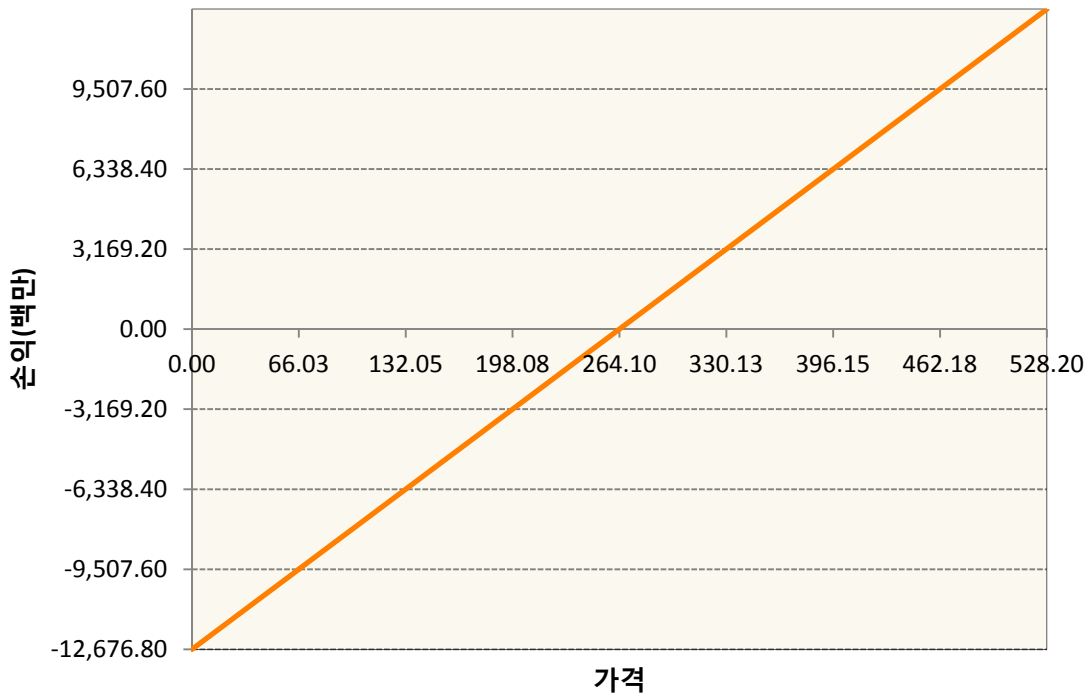
1. 계약금액

(단위:백만원)

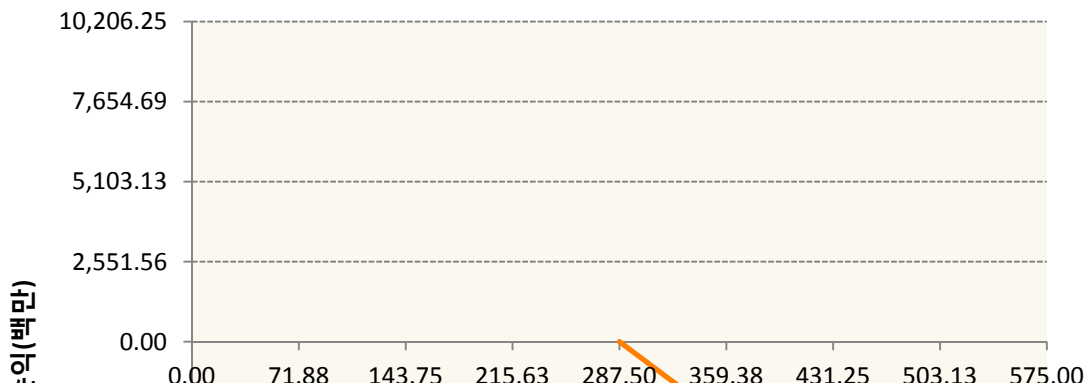
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,677	0	12,677	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

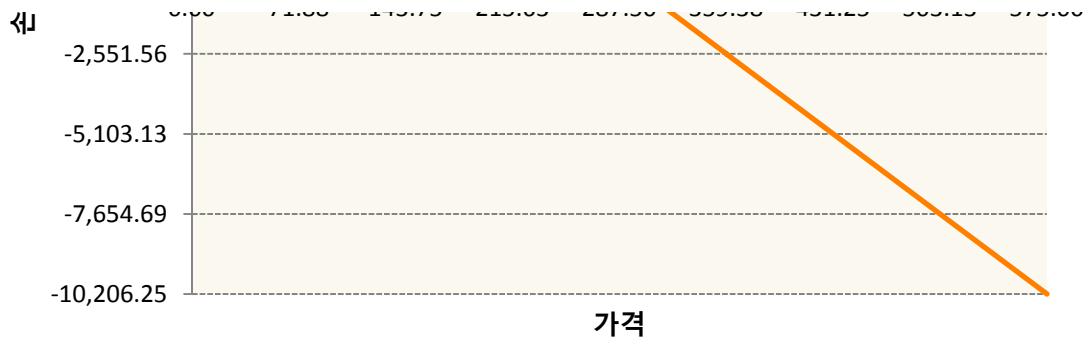
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

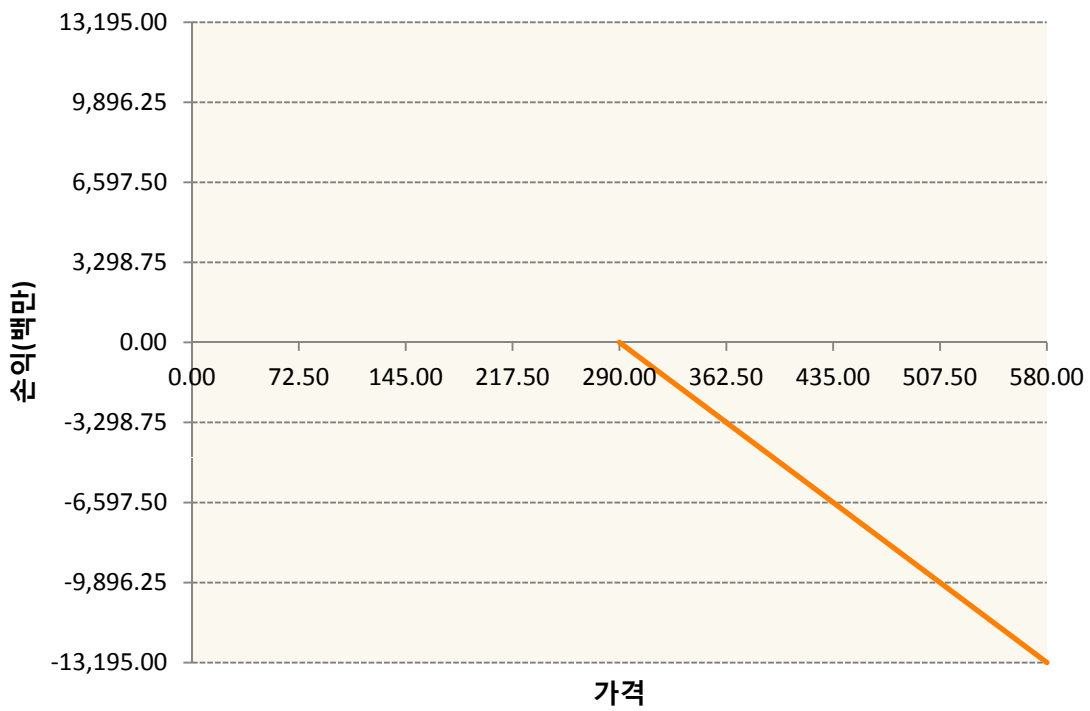


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

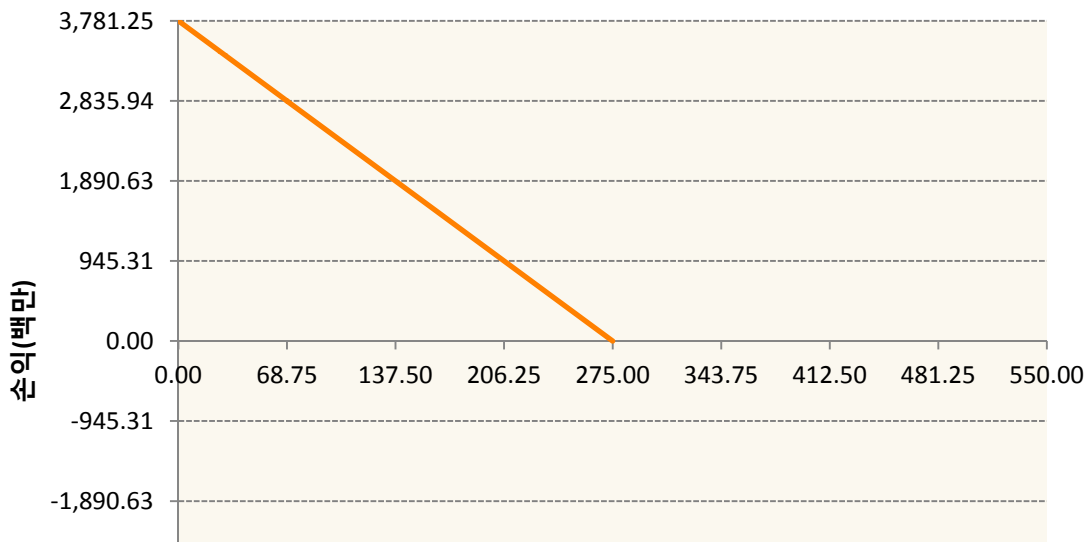


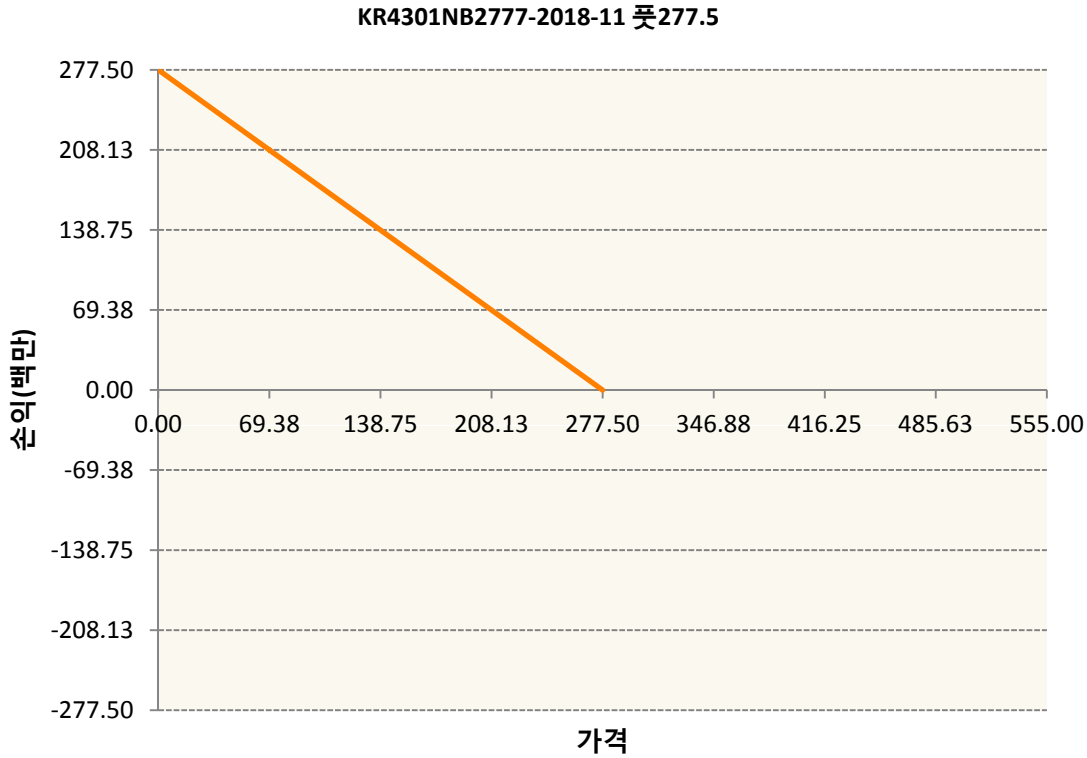
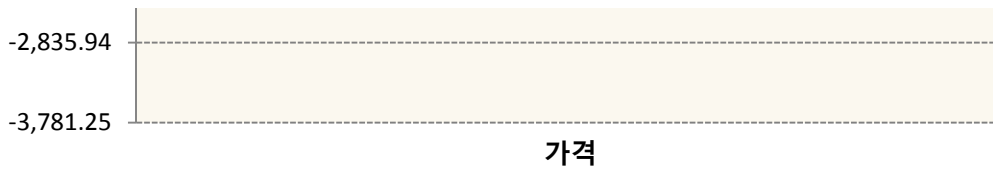


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물								1,014
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014
-5.33%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	338
5.33%	676	676	676	676	676	676	676	676
8.00%	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014
KR4201NB28 2018-11 콜287.5								167
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	3	2	1	0	

0%	3	2	1	0	-2	-4	-8
2.67%	0	-3	-7	-11	-17	-23	-30
5.33%	-20	-28	-37	-46	-57	-67	-78
8.00%	-85	-98	-112	-126	-139	-153	-167

KR4201NB29 2018-11 콜290

171

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	0
0%	2	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	0	-2	-5	-9	-14	-20	-27
5.33%	-14	-22	-31	-41	-52	-64	-76
8.00%	-72	-88	-104	-121	-137	-154	-171

KR4301NB27 2018-11 풋275

285

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	285	285	285	285	285	285	285
-5.33%	188	188	188	188	189	189	189
-2.67%	92	92	92	92	93	93	94
0%	-4	-3	-1	0	2	4	6
2.67%	-88	-84	-81	-78	-74	-71	-67
5.33%	-138	-135	-131	-127	-124	-120	-116
8.00%	-154	-153	-151	-149	-147	-145	-142

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-5
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,224

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

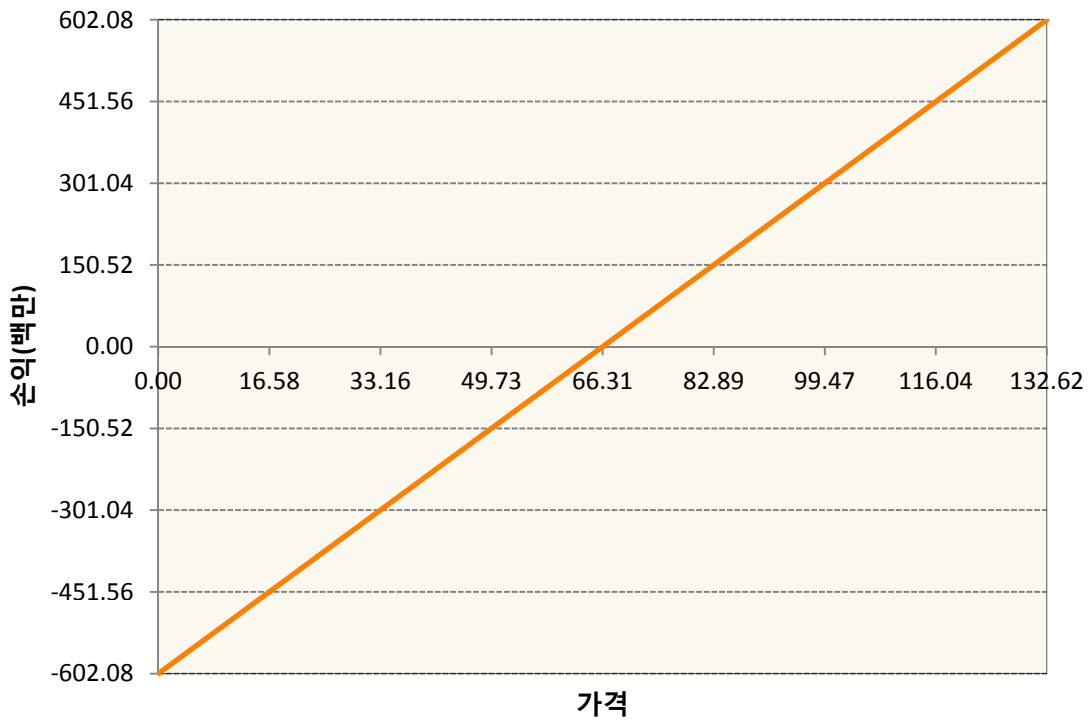
1. 계약금액

(단위:백만원)

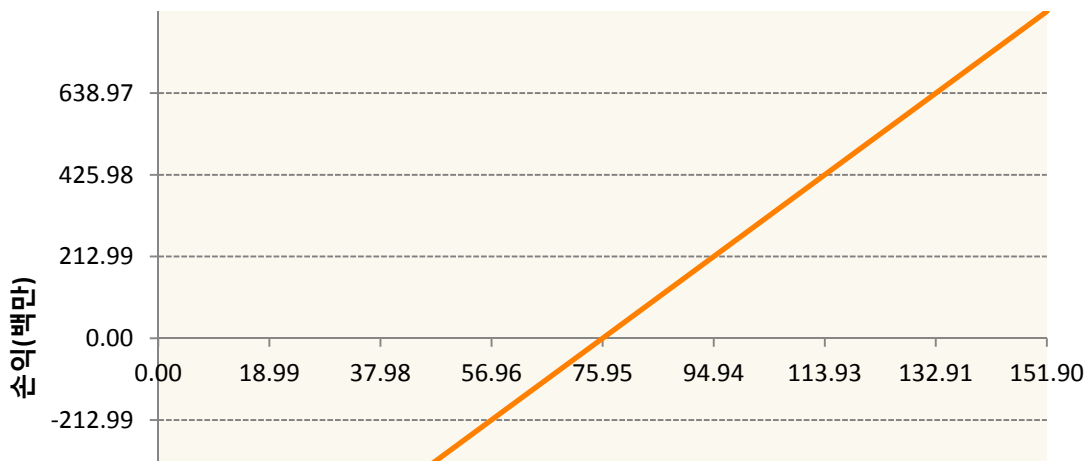
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,308	410	2,898	

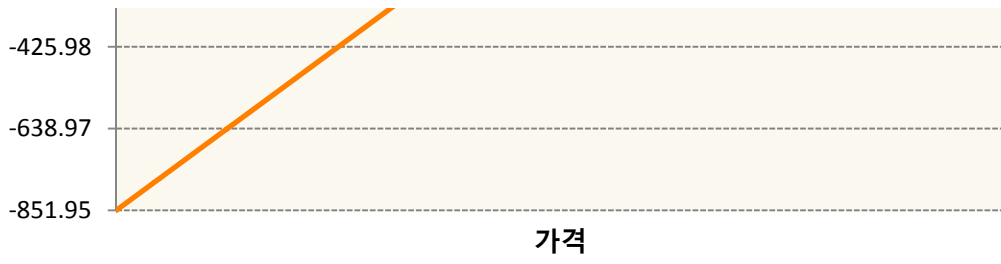
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

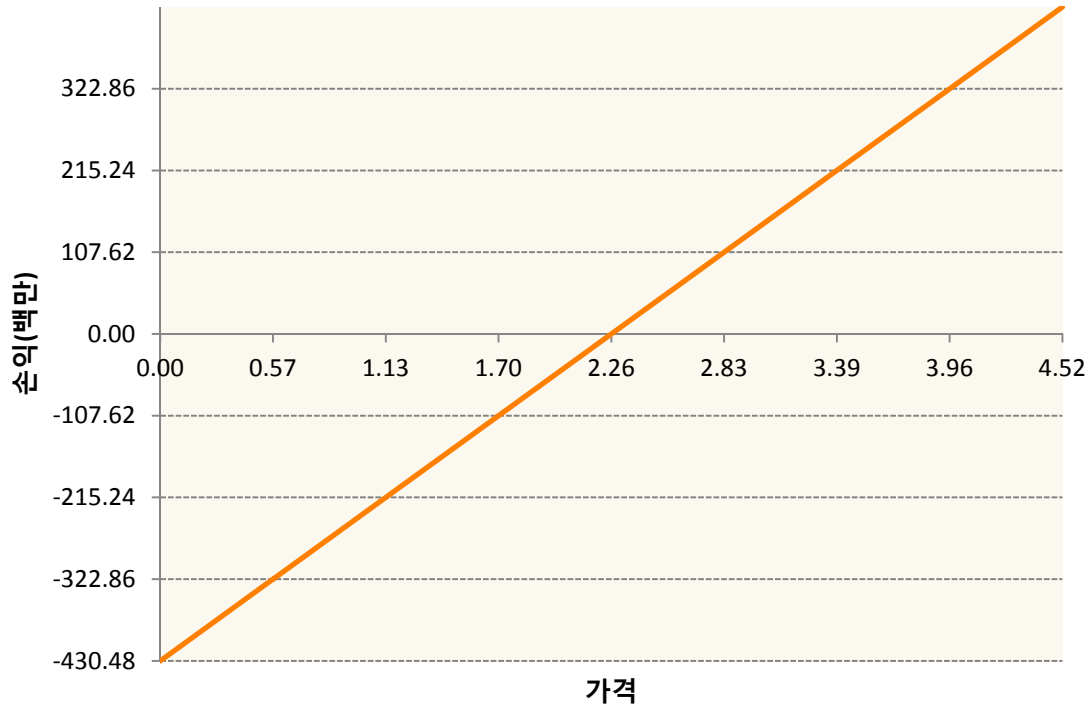


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

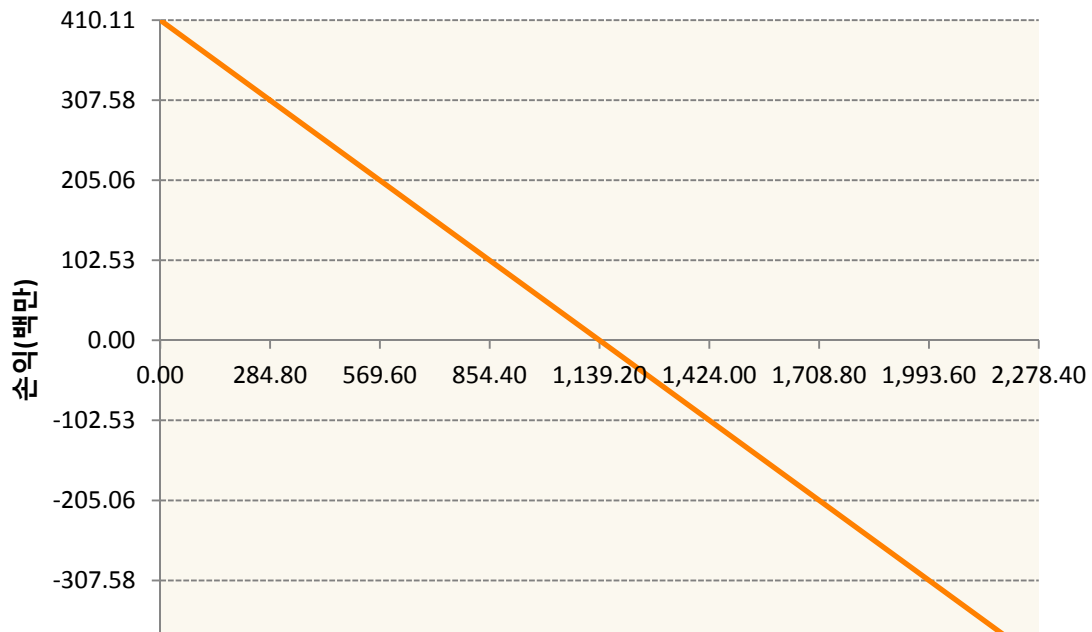


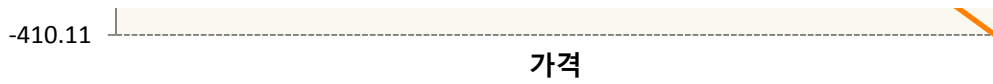


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

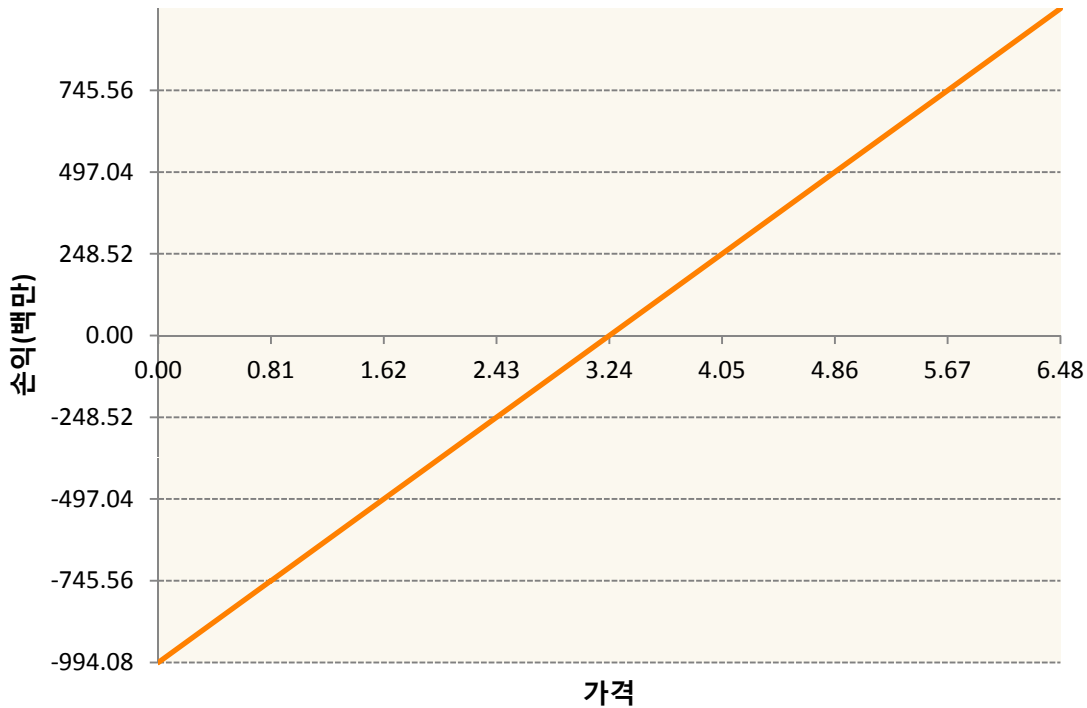


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

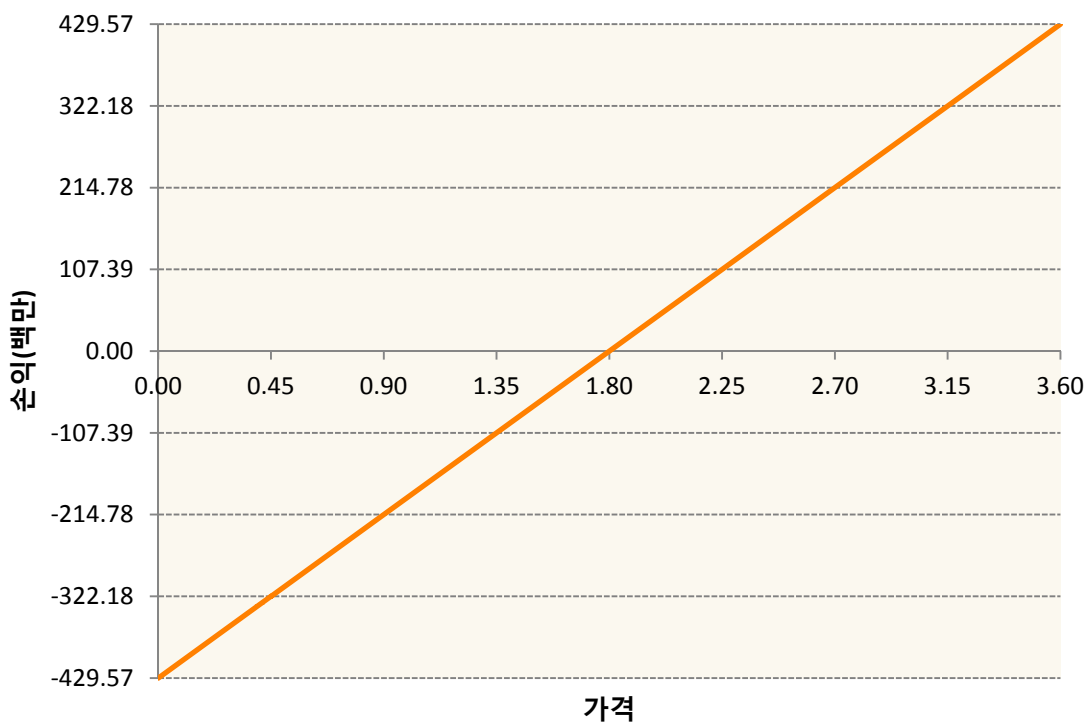




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	48
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	68
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	34
KR4175NB0(2018-11	달러선물	33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	80
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

399

공시일	2018-11-01
기준일	2018-10-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

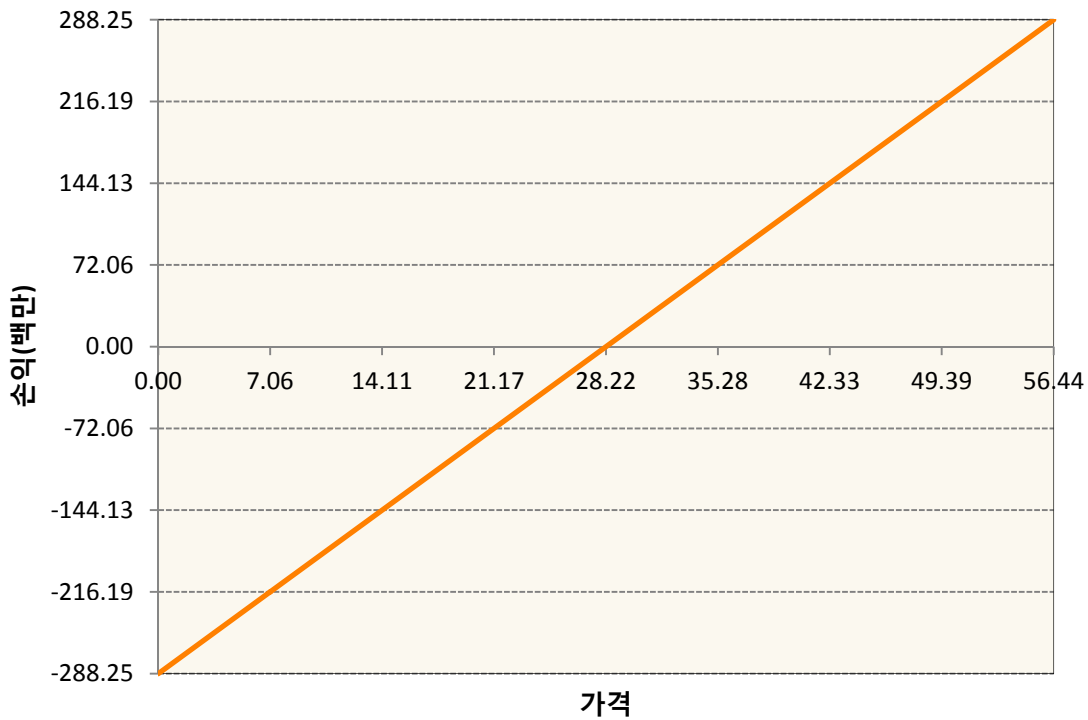
1. 계약금액

(단위:백만원)

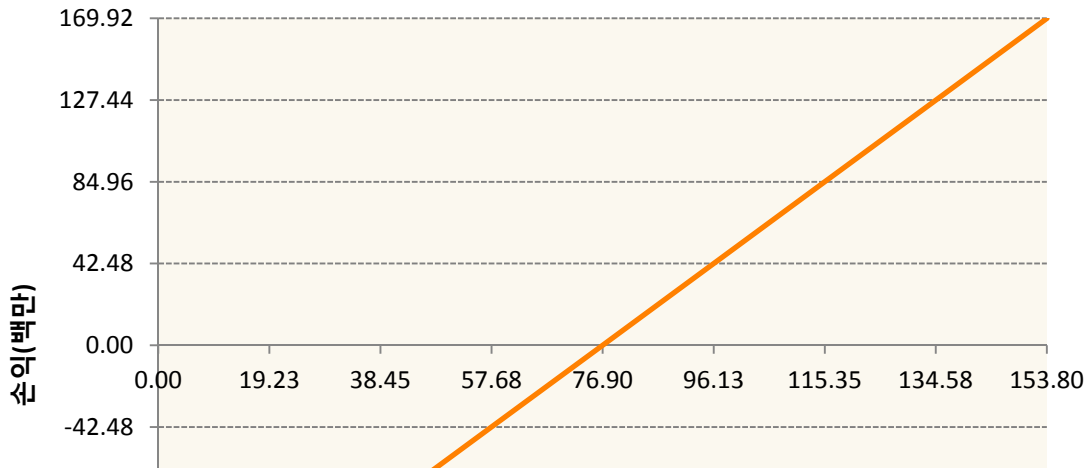
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,537	80	3,457	

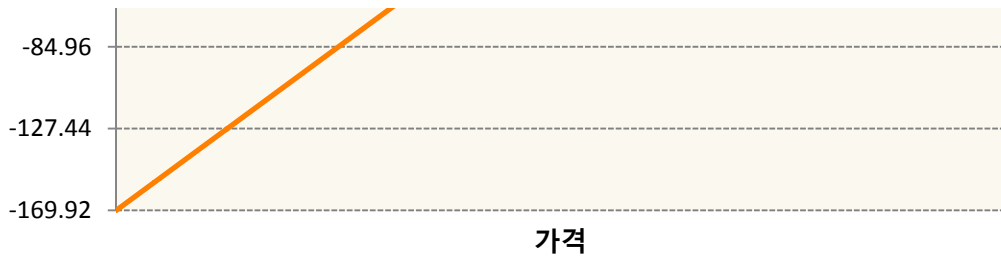
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

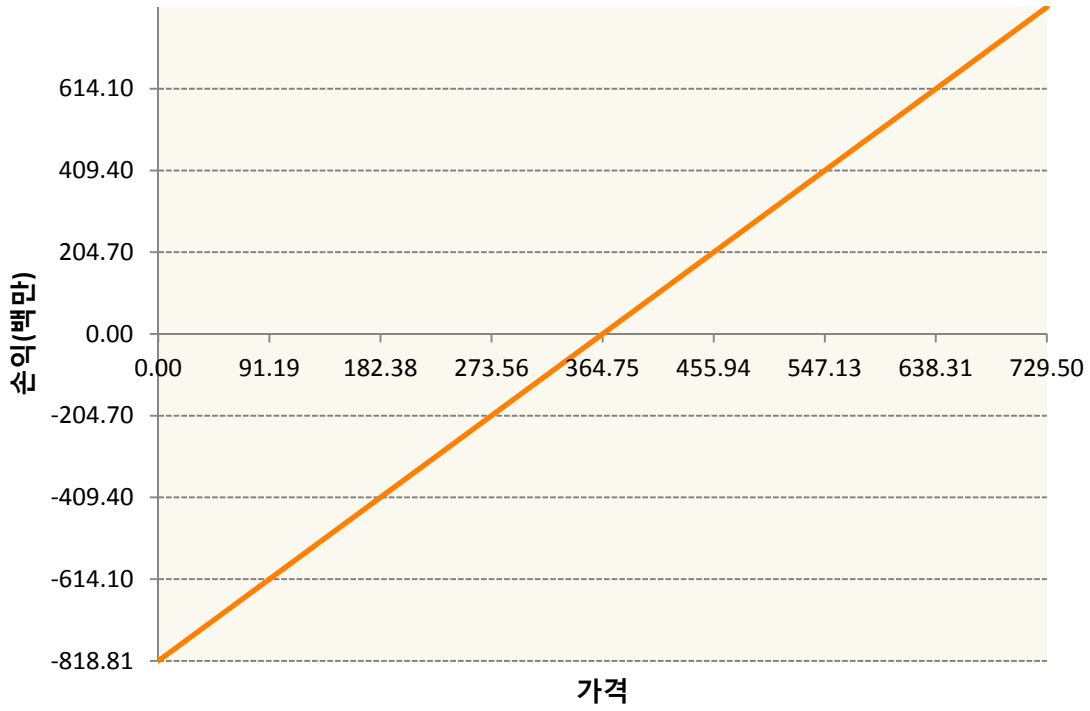


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

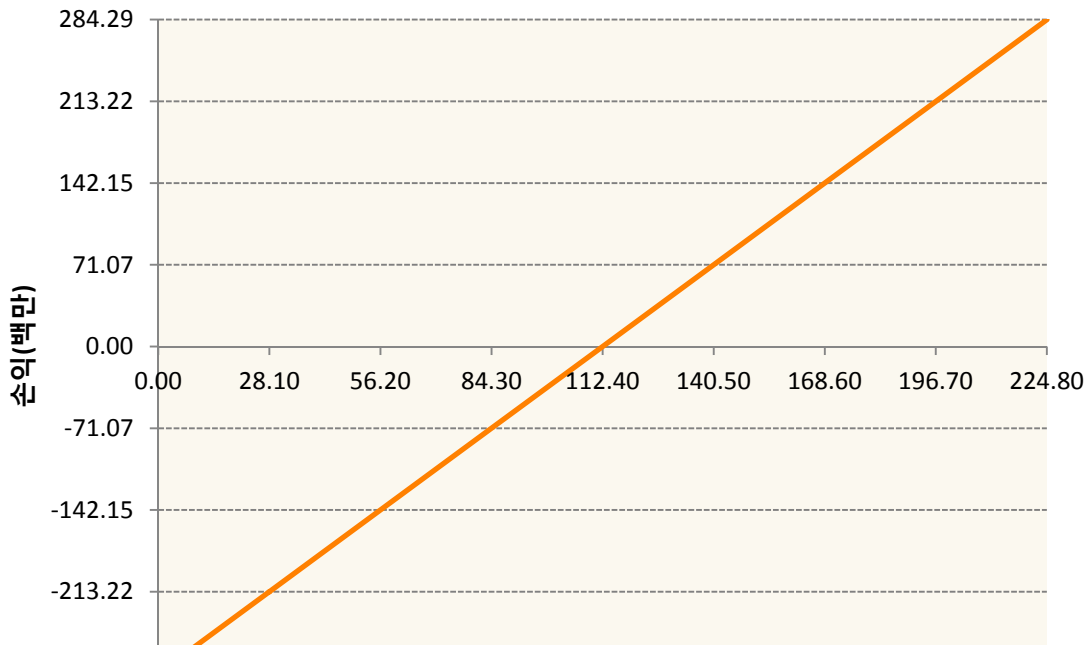


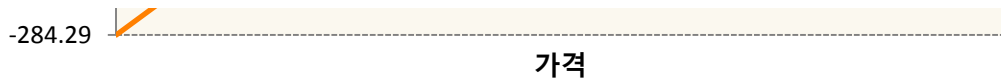


CZ8-CORN FUTURE DEC18

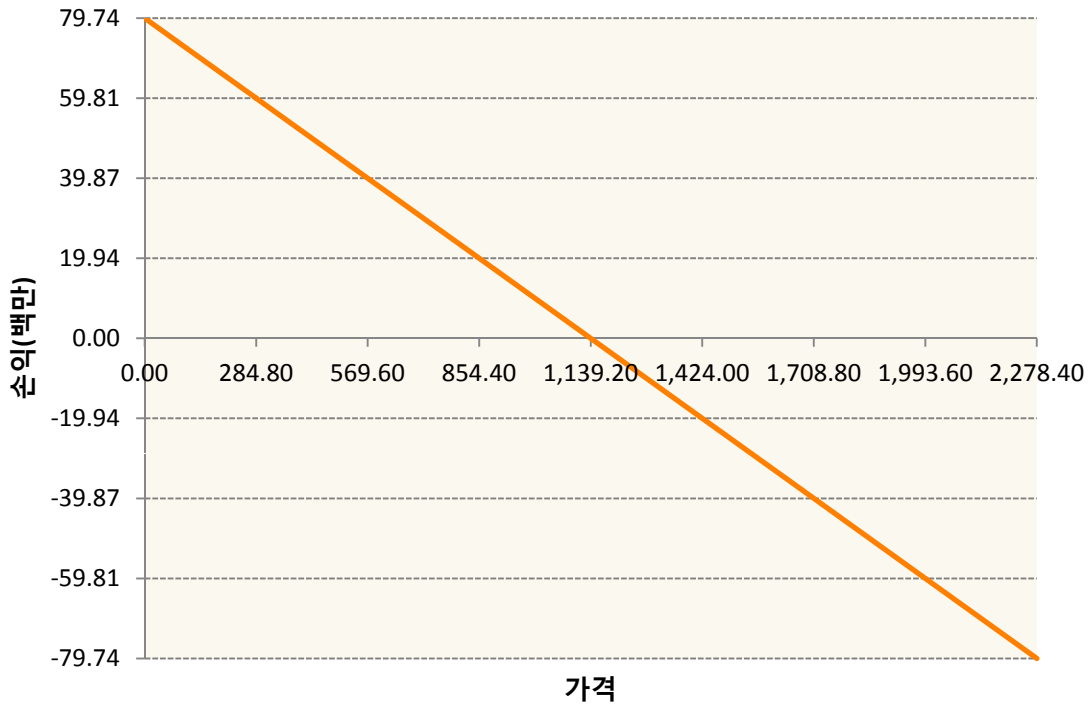


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

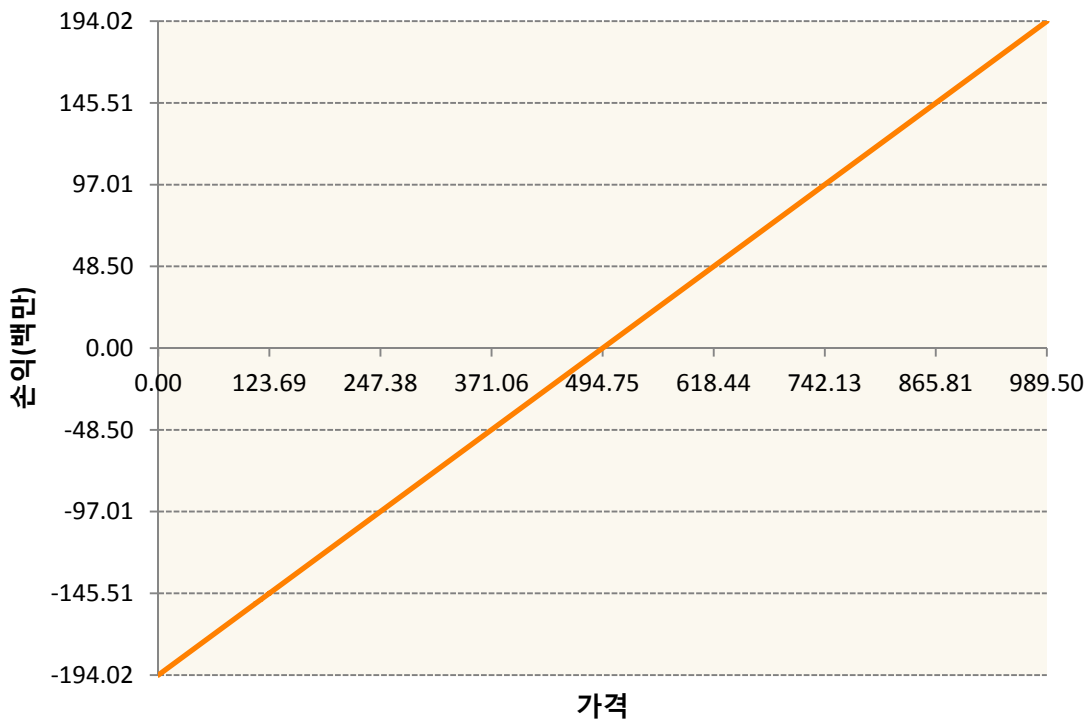




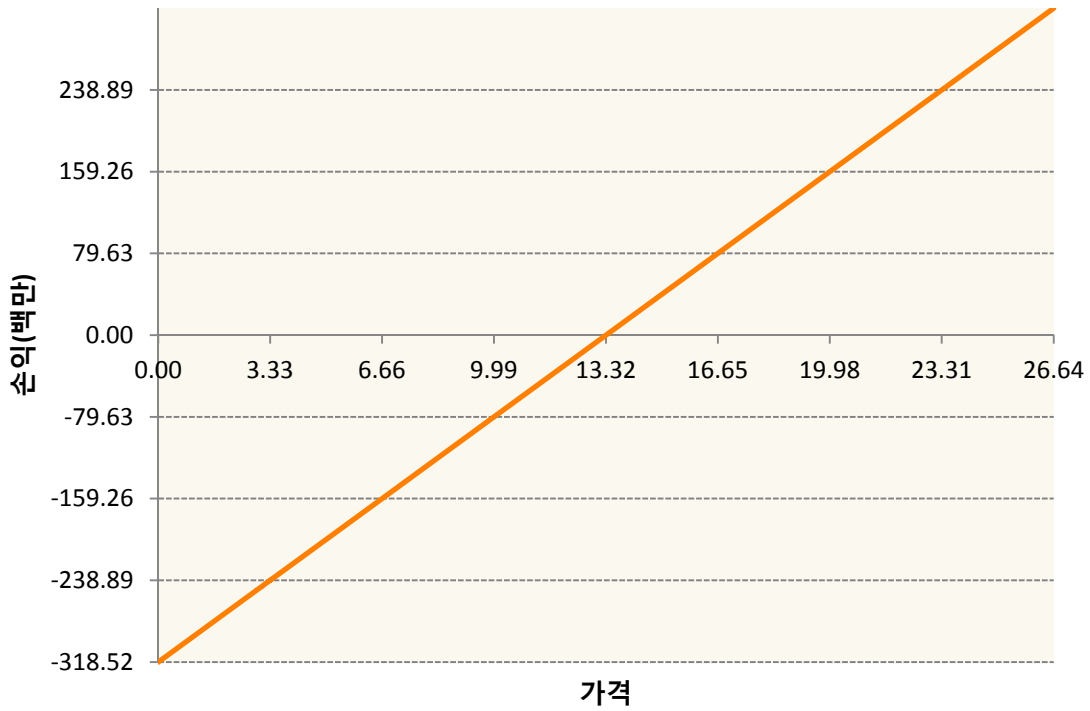
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



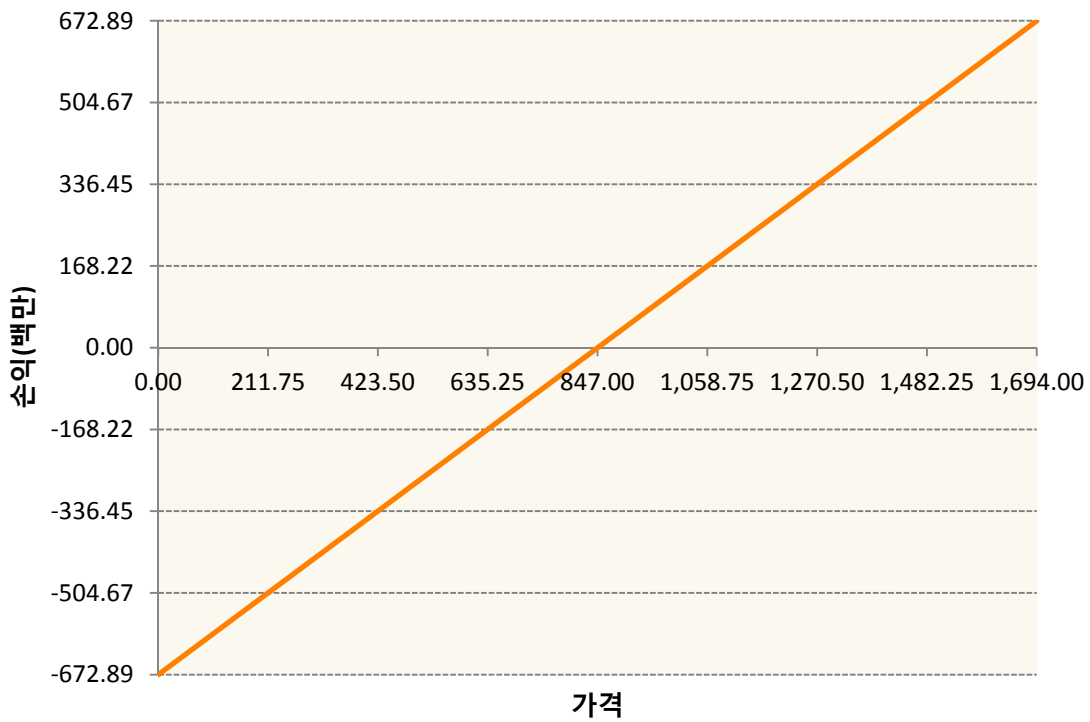
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

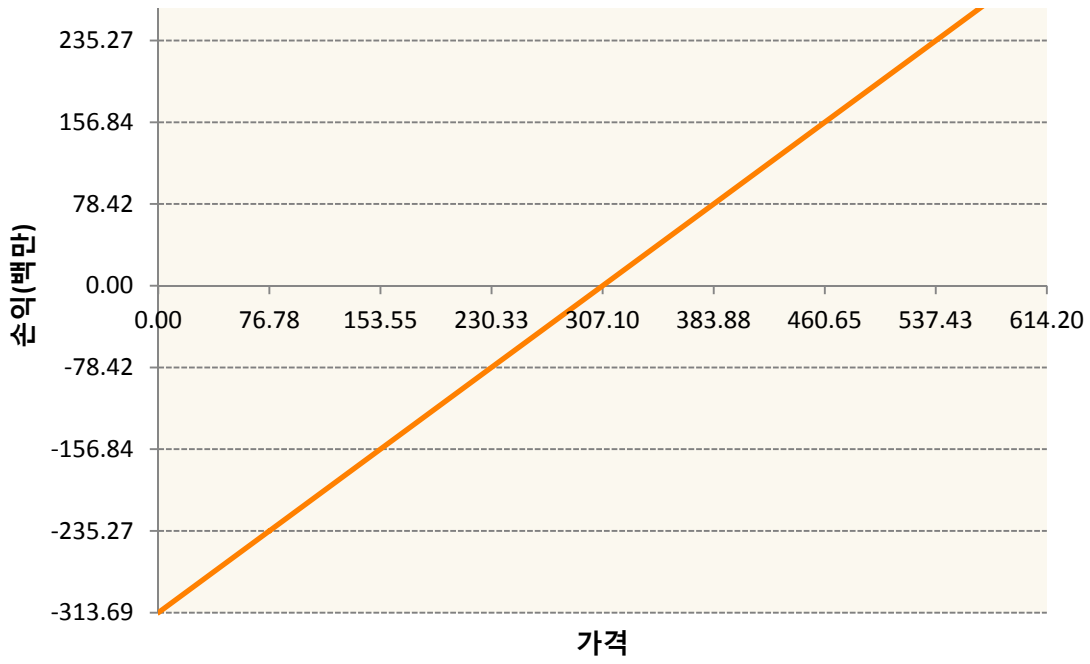


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

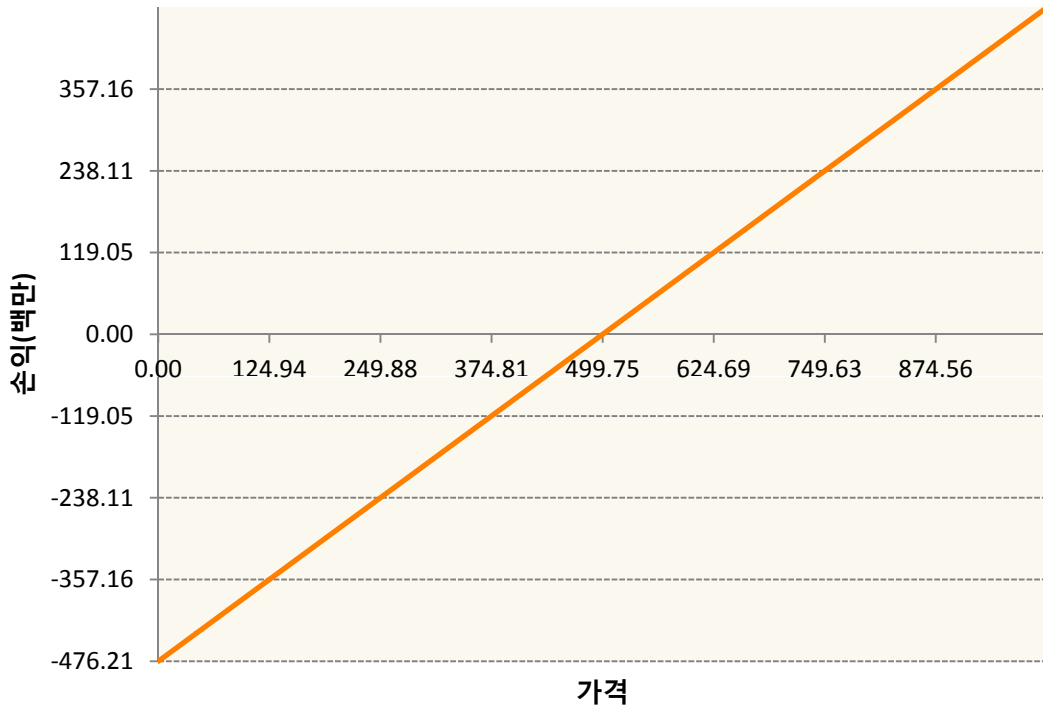


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	23
KR4175NB0(2018-11	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	54
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

308